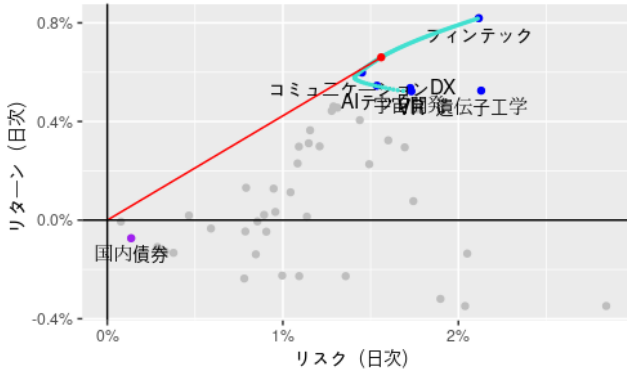


eMAXIS シリーズ（+米ドル、ゴールド、高配当株式ファンド）を使った効率的ポートフォリオ

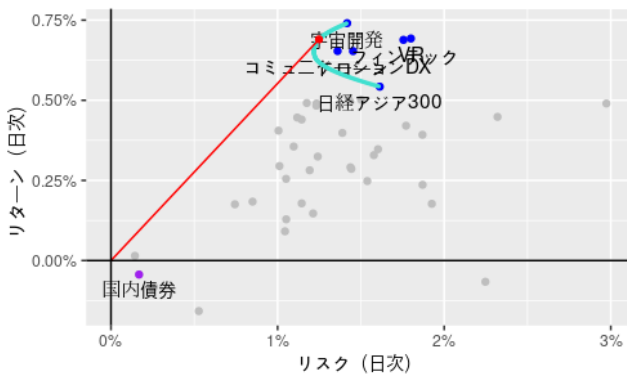
2024年10月19日

【半月】



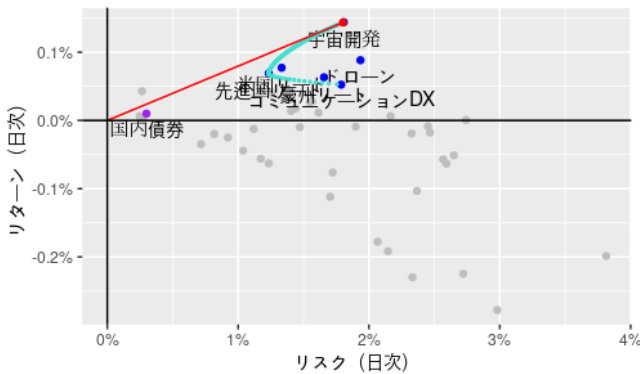
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.660%	1.560%	0.423	—
フィンテック	0.819%	2.116%	0.387	28.0%
コミュニケーション DX	0.599%	1.451%	0.412	72.0%
AI テック	0.545%	1.536%	0.355	0.0%
宇宙開発	0.536%	1.726%	0.310	0.0%
遺伝子工学	0.525%	2.130%	0.247	0.0%
VR	0.522%	1.732%	0.302	0.0%

【一ヶ月】



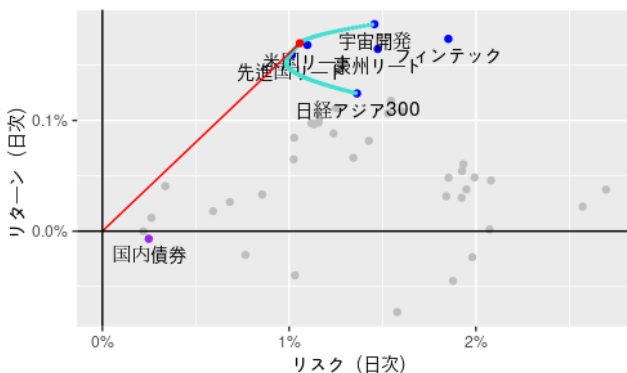
eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.690%	1.249%	0.553	—
宇宙開発	0.741%	1.418%	0.522	41.9%
VR	0.693%	1.800%	0.385	0.0%
フィンテック	0.688%	1.756%	0.392	0.0%
コミュニケーション DX	0.654%	1.360%	0.481	33.0%
ドローン	0.653%	1.453%	0.450	25.1%
日経アジア 300	0.542%	1.613%	0.336	0.0%

【四半期】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.143%	1.802%	0.080	—
宇宙開発	0.144%	1.808%	0.080	99.3%
ドローン	0.088%	1.935%	0.046	0.0%
米国リート	0.077%	1.333%	0.058	0.7%
先進国リート	0.069%	1.234%	0.056	0.0%
豪州リート	0.063%	1.656%	0.038	0.0%
コミュニケーション DX	0.052%	1.788%	0.029	0.0%

【半年】

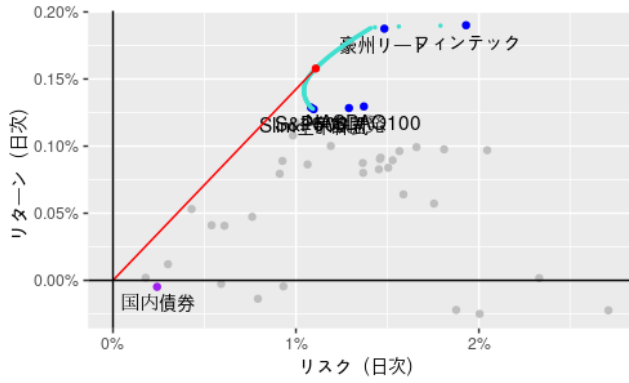


eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.170%	1.057%	0.161	—
宇宙開発	0.187%	1.457%	0.128	12.4%
フィンテック	0.174%	1.852%	0.094	0.0%
米国リート	0.168%	1.098%	0.153	67.4%
豪州リート	0.165%	1.474%	0.112	20.2%
先進国リート	0.159%	1.014%	0.157	0.0%
日経アジア 300	0.124%	1.363%	0.091	0.0%

備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。

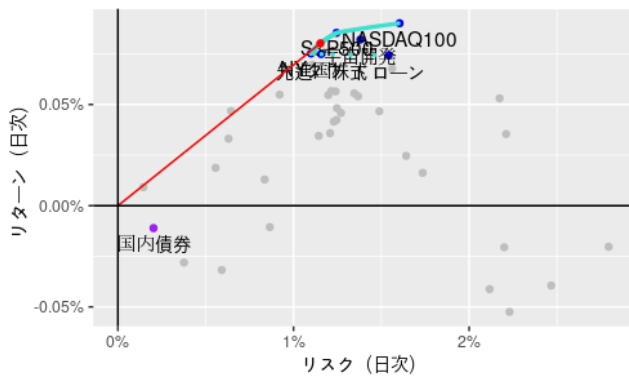
(2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

【一年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.158%	1.109%	0.142	—
フィンテック	0.190%	1.930%	0.098	2.9%
豪州リート	0.187%	1.483%	0.126	46.5%
NASDAQ100	0.130%	1.371%	0.094	0.0%
S&P500	0.129%	1.082%	0.119	50.6%
宇宙開発	0.128%	1.290%	0.100	0.0%
Slim 全米株式	0.127%	1.097%	0.116	0.0%

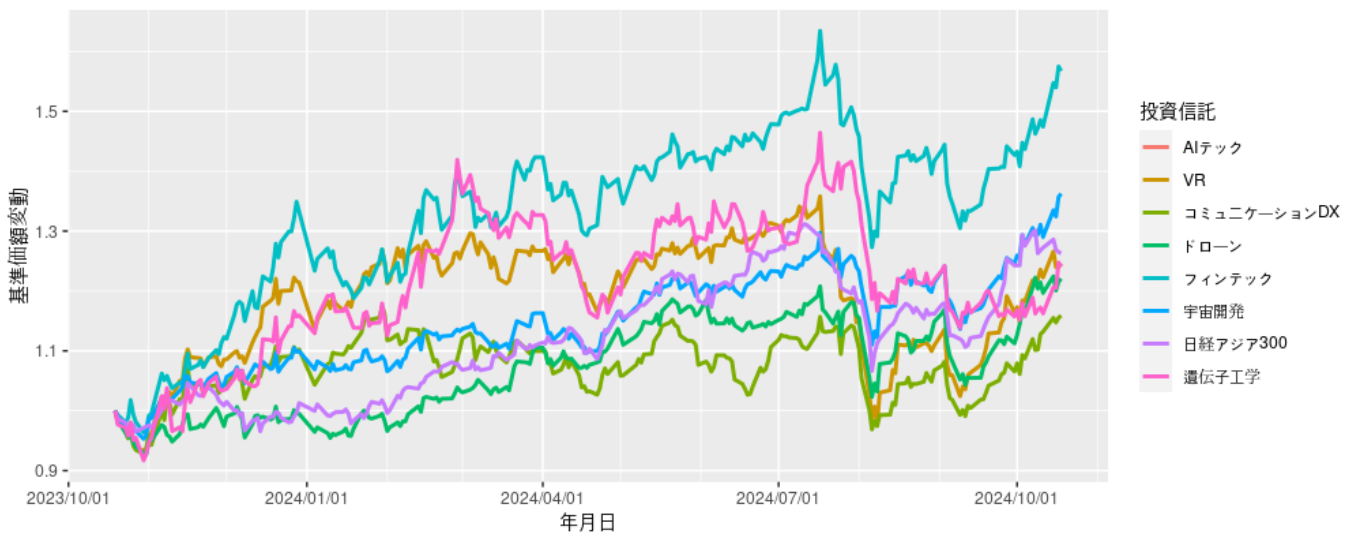
【三年】



eMAXIS	リターン	リスク	t 値	割合
効率的ポートフォリオ	0.080%	1.153%	0.070	—
NASDAQ100	0.090%	1.604%	0.056	0.0%
S&P500	0.085%	1.245%	0.069	49.4%
宇宙開発	0.082%	1.381%	0.059	0.0%
NY ダウ	0.075%	1.099%	0.068	50.6%
先進国株式	0.075%	1.157%	0.065	0.0%
ドローン	0.074%	1.542%	0.048	0.0%

備考 (1) グラフ中の赤点 (・) は効率的ポートフォリオのリターンとリスクを示す。
 (2) リターンとリスクは日次で、240 営業日を掛けると概ね年率の値になる。

eMAXIS シリーズでリターンが高かった銘柄の基準価額の変動



備考 直近半月と一ヶ月でリターン上位の銘柄について一年前を 1 として直近一年間の価額変動を示す。